

淡江大學 107 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	期貨資產管理實務	授課 教師	李姿錡 LEE, TZU-CHI
	MANAGED FUTURES		
開課系級	共同科－商管 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TGLXB0A		
系（所）教育目標			
<p>一、習得瞭解專業知識。</p> <p>二、有效學習自我規劃。</p> <p>三、植基理論契合實務。</p> <p>四、人際溝通團隊合作。</p> <p>五、分析問題提供建議。</p> <p>六、道德知覺全球公民。</p>			
系（所）核心能力			
<p>A. 熟悉商管專業的基本知識。</p> <p>B. 具備專業知識的表達能力。</p> <p>C. 具備資訊蒐集運用的能力。</p> <p>D. 具體審辨分析的思考能力。</p>			
課程簡介	<p>近年來全球養老基金、保險基金、捐贈基金、慈善基金..等，對管理期貨基金CTA(Managed Futures)此一投資工具表現出濃厚的投資興趣，隨著參與資金的成長，期貨管理基金的規模急劇膨脹在全球期貨和期權市場中的作用和影響日漸顯現。因應此一趨勢，本課程主要在培育期貨專業資產管理人才，從投資分析，衍生性金融商品論述，程式交易運用，管理期貨基金及ETF編制帶領大家更進一步了解期貨資產管理實務。</p>		
	<p>In recent years, the global funds have shown a strong interest in the investment tool of the management futures fund. As the scale of CTA(Managed Futures) is expanding rapidly, the role and influence of the CTA fund in the global futures and options market is becoming increasingly apparent. In response to this trend, this course is mainly to cultivate future professional asset management personnel, from investment analysis, derivative financial commodity introduction, program trading application, managed futures and ETF to guide people to further understand the futures asset management.</p>		

本課程教學目標與目標層級、系(所)核心能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「系(所)核心能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應其「系(所)核心能力」。單項教學目標若對應「系(所)核心能力」有多項時，則可填列多項「系(所)核心能力」。(例如：「系(所)核心能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列。)

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	系(所)核心能力
1	培養期貨資產管理人才	Futures asset management personnel training	P6	ABCD
2	了解各項金融商品的知識與特性	Understand the knowledge and characteristics of various financial products	C2	ABC
3	了解投資市場的分析工具	Analytical tools for understanding investment markets	C4	ABC
4	透過交易了解衍生性金融商品在投資市場的運作	Understanding the operation of derivatives in investment markets through trading	A3	BC
5	程式交易在投資市場的運用	Application of program trading in investment market	C3	BCD

教學目標之教學方法與評量方法

序號	教學目標	教學方法	評量方法
1	培養期貨資產管理人才	講述、模擬、實作、問題解決	紙筆測驗、報告、上課表現
2	了解各項金融商品的知識與特性	講述、討論	紙筆測驗、實作、報告、上課表現
3	了解投資市場的分析工具	講述、討論、模擬	紙筆測驗、報告、上課表現
4	透過交易了解衍生性金融商品在投資市場的運作	講述、討論	紙筆測驗、實作、報告、上課表現
5	程式交易在投資市場的運用	講述、討論、模擬	紙筆測驗、實作、報告、上課表現

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養

淡江大學校級基本素養	內涵說明
◆ 全球視野	培養認識國際社會變遷的能力，以更寬廣的視野了解全球化的發展。
◆ 資訊運用	熟悉資訊科技的發展與使用，並能收集、分析和妥適運用資訊。
◆ 洞悉未來	瞭解自我發展、社會脈動和科技發展，以期具備建構未來願景的能力。
◆ 品德倫理	了解為人處事之道，實踐同理心和關懷萬物，反省道德原則的建構並解決道德爭議的難題。
◆ 獨立思考	鼓勵主動觀察和發掘問題，並培養邏輯推理與批判的思考能力。
◆ 樂活健康	注重身心靈和環境的和諧，建立正向健康的生活型態。
◇ 團隊合作	體察人我差異和增進溝通方法，培養資源整合與互相合作共同學習解決問題的能力。
◇ 美學涵養	培養對美的事物之易感性，提升美學鑑賞、表達及創作能力。

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	107/09/10~ 107/09/16	課程介紹	
2	107/09/17~ 107/09/23	期貨、選擇權、衍生性金融商品概論及策略運用-1	
3	107/09/24~ 107/09/30	期貨、選擇權、衍生性金融商品概論及策略運用-2	
4	107/10/01~ 107/10/07	國內外股價指數、股票期貨及選擇權市場解析	台灣期貨交易所
5	107/10/08~ 107/10/14	總體經濟及基本面分析	
6	107/10/15~ 107/10/21	技術分析理論及實務	
7	107/10/22~ 107/10/28	期貨交易策略實務運用	金融研訓院講師
8	107/10/29~ 107/11/04	洗錢防制打擊資恐	市調處洗錢防治單位
9	107/11/05~ 107/11/11	金融商品的風險管理	富邦期貨總經理
10	107/11/12~ 107/11/18	期中考試週	
11	107/11/19~ 107/11/25	國際金融體系及期貨信託基金發展	期貨公會副秘書長
12	107/11/26~ 107/12/02	交易程式的編譯與實務運用-1	期信基金經理人

13	107/12/03~ 107/12/09	交易程式的編譯與實務運用-2	期信基金經理人
14	107/12/10~ 107/12/16	期貨避險基金管理操作實務及ETF、編制與實務運用	ETF基金經理人
15	107/12/17~ 107/12/23	專題演講--金融科技之發展及創新	永豐期貨副總經理
16	107/12/24~ 107/12/30	專題演講--金融犯罪與實例	台北市調處調查官
17	107/12/31~ 108/01/06	元旦假期	
18	108/01/07~ 108/01/13	期末考試週	
修課應 注意事項	需具備金融商品知識及簡易程式編譯概念，踴躍發言、實務體驗分享		
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	自編講義		
參考書籍	黃昱程著，期貨與選擇權：衍生性金融商品入門經典，2015，華泰文化出版 謝劍平著，現代投資銀行，2018，智勝出版社 楊朝成、陳勝源著，投資學概論，2015，華泰出版社 林哲鵬著，投資學理論與實務，2016，華泰出版社		
批改作業 篇數	1 篇（本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫）		
學期成績 計算方式	◆出席率： 20.0 % ◆平時評量：10.0 % ◆期中評量：20.0 % ◆期末評量：20.0 % ◆其他〈作業成績/程式運用〉：30.0 %		
備 考	「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/CS/main.php 〉業務連結「教師教學 計畫表上傳下載」進入。 ※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。		